

A ENTROPIA COMO MEDIDA DE INFORMAÇÃO NA MODELAÇÃO ECONÓMICA

Andreia Dionísio^{*}, Rui Menezes^{**} e Diana Mendes^{***}

RESUMO:

Neste artigo, é analisada a entropia como medida de informação e incerteza na modelação económica. Tal aplicação é justificada pelas limitações apresentadas pelos tradicionais modelos económico-financeiros, nomeadamente quanto à forma como é medida a incerteza, e pelas similaridades existentes entre a física, a teoria da informação e a teoria económico-financeira. A forma como a entropia é adoptada pela teoria da informação, assumindo-se como a incerteza patente numa determinada distribuição de probabilidade é utilizada no seio da teoria económica, que a encara como medida de dispersão global, de incerteza e, acima de tudo, como medida de informação, revelando-se eficaz na avaliação de activos financeiros e de mercados. São dados alguns exemplos de aplicação, sendo de realçar as similitudes existentes entre a entropia e informação mútua e a regressão linear.

PALAVRAS-CHAVE:

Entropia, informação mútua, incerteza, distribuição de probabilidade

^{*} Departamento de Gestão, Universidade de Évora, 7000 Évora, Portugal
e-mail: andreia@uevora.pt

^{**} Professor Auxiliar do Departamento de Métodos Quantitativos, ISCTE,
e-mail: rui.menezes@iscte.pt

^{***} Assistente do Departamento de Métodos Quantitativos do ISCTE
e-mail: diana.mendes@iscte.pt